

Облікова картка ДіР



I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0222U001535

Державний реєстраційний номер: 0120U101508

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 28-01-2022

II. Етап виконання ДіР

Номер етапу: 2

Назва етапу: Розробка науково-практичних та методичних рекомендацій із формування ризик-орієнтованої системи накопичувального пенсійного забезпечення

Початок етапу: 01.2021

Закінчення етапу: 12.2021

Вид звітнього документа: Остаточний звіт

III. Відомості про виконавця ДіР

Повне найменування юридичної особи (або ПІБ фізичної особи): Харківський національний економічний університет імені Семена Кузнеця

Код за ЄДРПОУ: 02071211

Місцезнаходження: проспект Науки, буд. 9-а, м. Харків, Харківський р-н., Харківська обл., 61166, Україна

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

Розмір організації:

Телефон: 380577020304, 380577020717

IV. Відомості про співвиконавців ДіР

V. Відомості про замовника ДіР

Повне найменування юридичної особи (або ПІБ фізичної особи): Міністерство освіти і науки України

Код за ЄДРПОУ: 38621185

Місцезнаходження: просп. Перемоги, буд. 10, м. Київ, Київська обл., 01135, Україна

Форма власності:

Сфера управління: Кабінет Міністрів України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

Розмір організації:

Телефон: 380444813221

VI. Джерела, напрями та обсяги фінансування ДіР

Підстава для проведення ДіР: 34 - договір (замовлення) з центральним органом виконавчої влади, академією наук (головними розпорядниками бюджетних коштів на проведення НДДКР)

Напрямок фінансування: 2.2 - прикладні дослідження і розробки

Джерела фінансування

7713 - кошти держбюджету

Код програмної класифікації видатків і кредитування (КПКВК): 2201040

Фактичний обсяг фінансування (тис. грн.): 440.000
--

VII. Відомості про ДіР

Назва роботи українською:

Формування ризик-орієнтованої системи накопичувального пенсійного забезпечення

Назва роботи англійською:

Formation of a risk-oriented system of funded pension provision

Реферат українською:

Об'єктом дослідження обрано процес функціонування сфери накопичувального пенсійного забезпечення, а його предметом – теоретично-методичні положення, методичний та практичний інструментарій формування ризик-орієнтованої системи накопичувального пенсійного забезпечення. Метою наукової роботи є розробка новітніх підходів до формування ризик-орієнтованої системи накопичувального пенсійного забезпечення на основі застосування науково-методичних положень та практичного інструментарію до її формування. Для досягнення мети у роботі: сформовано профіль ризиків системи накопичувального пенсійного забезпечення та запропоновано заходи щодо їх мінімізації; удосконалено методичний підхід до оцінки ризиків діяльності страхових компаній зі страхування життя на ринку фінансових послуг з недержавного пенсійного забезпечення; обґрунтовано інформаційно-аналітичну систему дотримання умов належної обачності суб'єктів первинного фінансового моніторингу, що є суб'єктами системи накопичувального пенсійного забезпечення; удосконалено механізм превентивного державного макро- та мікропруденційного регулювання та нагляду у ризик-орієнтованій системі накопичувального пенсійного забезпечення; сформовано план перерозподілу накопичених активів у кластері суб'єктів пенсійної системи з використання інформаційних технологій; розроблено методику ризик-орієнтованого вибору складу напрямів інвестування пенсійних активів та структурних обмежень для інвестування для різних типів пенсійного портфеля; удосконалено склад показників для оцінювання ефективності реалізації стратегії формування ризик-орієнтованої системи накопичувального пенсійного забезпечення, запропоновано рекомендації щодо напрямів вдосконалення.

Реферат англійською:

The object of the study is the process of functioning of the accumulative pension provision, and its subject are theoretical and methodological provisions, methodological and practical tools for the formation of risk-oriented system of accumulative pension provision. The purpose of scientific work is to develop new approaches to the formation of risk-oriented system of accumulative pension provision based on the application of scientific and methodological provisions and practical tools for its formation. To achieve the goal in the research work: the risk profile of the of accumulative pension provision is formed and measures to minimize them are proposed; improved methodological approach to risk assessment of life insurance companies' activities in the market of private pension provision financial services; the information-analytical system of observance of the conditions of due diligence of primary financial monitoring subjects, which are the subjects of the accumulative pension provision system, is substantiated; the mechanism of preventive state macro- and micro-prudential regulation and supervision in the risk-oriented system of accumulative pension provision has been improved; formed a plan for the redistribution of accumulated assets in the cluster of the pension system subjects based on the information technology; developed a methodology for risk-oriented choice of the composition of areas of pension assets investment and structural restrictions for investment for different types of pension portfolio; the composition of indicators for assessing the effectiveness of the strategy for the formation of a risk-oriented system of accumulative pension provision and recommendations on areas for improvement have been proposed.

Індекс УДК: 330.341:316.4; 330.35:316.4, 336.11

Коди тематичних рубрик: 06.52.17, 06.73.02

Керівники роботи

Власне Прізвище Ім'я По-батькові: Ачкасова Світлана Анатоліївна

Науковий ступінь:

Вчене звання:

Ідентифікатор ORCID ID:

Додаткова інформація:

VIII. Наукова (науково-технічна) продукція (НТП)

Назва НТП українською: Профіль ризиків системи накопичувального пенсійного забезпечення та заходи щодо їх мінімізації. Інформаційно-аналітична система дотримання умов належної обачності суб'єктів первинного фінансового моніторингу, що є суб'єктами системи накопичувального пенсійного забезпечення. Механізм превентивного державного макро- та мікропруденційного регулювання та нагляду у ризик-орієнтованій системі накопичувального пенсійного забезпечення. Методика ризик-орієнтованого вибору складу напрямів інвестування пенсійних активів та структурних обмежень для інвестування для різних типів пенсійного портфеля; Склад показників для оцінювання ефективності реалізації стратегії формування ризик-орієнтованої системи накопичувального пенсійного забезпечення та запропоновані рекомендації щодо напрямів вдосконалення. Методичний підхід до оцінки ризиків діяльності страхових компаній зі страхування життя на ринку фінансових послуг з недержавного пенсійного забезпечення.

Назва НТП англійською: A risk profile of the accumulative pension provision system and measures to minimize them. An information-analytical system of observance of the conditions of due diligence of primary financial monitoring subjects, which are the subjects of the accumulative pension provision system. A mechanism of preventive state macro- and micro-prudential regulation and supervision in the risk-oriented system of accumulative pension provision. A methodology for risk-oriented choice of the composition of areas of pension assets investment and structural restrictions for investment for different types of pension portfolio. A composition of indicators for assessing the effectiveness of the strategy for the formation of a risk-oriented system of accumulative pension provision and recommendations on areas for improvement. A methodical approach to risk assessment of life insurance companies' activities in the market of private pension provision financial services.

НТП, яку передбачалося створити:

Причини, через які НТП не було створено:

Отримані результати: Набудуть подальший розвиток: профіль ризиків, ідентифікованих у системі накопичувального пенсійного забезпечення та практичний інструментарій захисту від них.

Галузь застосування: ринки фінансових послуг, сфера державних фінансів

Реєстраційний номер картки технології:

Опис НТП: Сформований профіль ризиків, ідентифікованих в системі накопичувального пенсійного забезпечення, та заходи щодо їх мінімізації спираються на уточнений перелік фінансових, демографічних, управлінських, актуарних, технологічних, політичних та психологічних ризиків, ґрунтуються на визначенні їх причин та взаємозв'язків, що дозволяє вдосконалити процес управління, мінімізації та захисту від них шляхом реалізації адекватним їм заходів із уникнення та попередження. Інформаційно-аналітична система дотримання умов належної обачності суб'єктів первинного фінансового моніторингу, що є суб'єктами системи накопичувального пенсійного забезпечення, враховує каузальний підхід та передбачає застосування когнітивного моделювання з метою визначення вузьких місць за волатильністю комплаєнс-ризиків СПФМ у сфері фінансового моніторингу при урахуванні зв'язку із наслідками їх реалізації (фінансовим та репутаційним ризиками), заходами впливу за порушення антилегалізаційного законодавства, ймовірністю залучення клієнтів у мережеві схеми, реалізації регулятором нагляду за діяльністю, та дозволяє визначити безпечність встановлення й підтримання ділових відносин між суб'єктами системи накопичувального пенсійного забезпечення. Механізм превентивного державного регулювання та нагляду (макро- та мікропруденційного) ґрунтується на виявленні ризик-орієнтованих ознак в основі довгострокового механізму підвищення довіри учасників цієї системи, враховує взаємодію елементів ризик-орієнтованої системи накопичувального пенсійного забезпечення, посилює необхідність здійснення контролю за коштами учасників, встановлення жорстких норм і єдиних стандартів щодо управління активами, упередження потенційних ризиків, контролю за витратами та проведення внутрішнього аудиту.

Соціально-економічна спрямованість НТП: Забезпечення промисловості чи населення новим видом інформаційно-комунікаційних послуг, Забезпечення належного рівня життя населення шляхом формування ризик-орієнтованої системи накопичувального пенсійного забезпечення у системі соціально-економічної безпеки.

Вплив НТП на довкілля:

Впровадження НТП: Впроваджено

Практична реалізація НТП

Початок етапу:

Закінчення етапу:

Споживачі продукції: Фінансові установи

Перспективні ринки:

Характер співробітництва з інвестором

Потрібний обсяг інвестицій, тис. грн.:

Права, що надаються інвестору після завершення роботи:

Наявність бізнес-плану:

Техніко-економічне обґрунтування:

Потенціальний обсяг продажу, тис. грн.:

Очікуваний термін окупності (років):

Додаткова інформація:

IX. Бібліографічний опис

1. Achkasova S. Implementation the fuzzy modeling technology by means of fuzzytech into the process of management the riskiness of business entities activity / S. Achkasova // Eastern-European Journal of Enterprise Technologies. – 2020. – Vol 5. – No 3 (107). – P. 39–54. DOI: <https://doi.org/10.15587/1729-4061.2020.209836>. – Режим доступу: <http://journals.uran.ua/eejet/article/view/209836>
2. Gorokhovatskyi O. Investigation of Random Neighborhood Features for Interpretation of MLP Classification Results / O. Gorokhovatskyi, O. Peredrii, V. Zatkhei, O. Teslenko // Advances in Intelligent Systems and Computing, 1020. – 2020. – P. 581–596. – Режим доступу: https://link.springer.com/chapter/10.1007/978-3-030-26474-1_40
3. Малишко Є. О. Аналіз впливу стратегічних пріоритетів на розвиток зовнішньоекономічної діяльності підприємств / Є. О. Малишко, В. В. Чернишов // Фінансово-кредитна діяльність: проблеми теорії та практики. – 2020. – № 3 (34). – С. 322–329. – Режим доступу: <https://fkd.ubs.edu.ua/index.php/fkd/article/view/2977>
4. Achkasova S. Identifying the volatility of compliance risks for the pension custodian banks / S. Achkasova, O. Bezrodna, Ye. Ohorodnia // Banks and Bank Systems. – 2021. – Vol. 16 (3). – P. 113–129. doi:10.21511/bbs.16(3).2021.11. Режим доступу: <https://www.businessperspectives.org/index.php/journals/banks-and-bank-systems/issue-389/identifying-the-volatility-of-compliance-risks-for-the-pension-custodian-banks>

5. Achkasova S., Nagaivska D., Sotnikova Yu., Bolotova O., Koinash M. Enhance the professional competence of specialists in the formation of accumulative pension system based on social responsibility / S. Achkasova, D. Nagaivska, Yu. Sotnikova, O. Bolotova, M. Koinash // Економічний часопис-XXI (Economic Annals-XXI). – 2021. – №190 (7/8)
6. Achkasova, S., & Malyshko, Y. (2021). Development an optimization plan for redistributing pension assets applying information technologies. Eastern-European Journal of Enterprise Technologies, 6(13 (114), 72–79. <http://journals.uran.ua/eejet/article/view/245384> Режим доступу: <http://journals.uran.ua/eejet/article/view/245384>
7. Achkasova S. Using the decision-making technology in organization of compliance in the sphere of accumulated pension provision / S. Achkasova // Technology Audit & Production Reserves. – 2020. – Vol. 5. – Issue 4(55). – P. 19–27. – Режим доступу: <http://journals.uran.ua/tarp/article/view/209051>
8. Малишко Є. О. Аналіз сучасного стану та розвитку системи пенсійного забезпечення в Україні / Є. О. Малишко // Інфраструктура ринку. – 2020. – Вип. 45/2020. – С. 233–241. – Режим доступу: http://www.market-infr.od.ua/journals/2020/45_2020_ukr/39.pdf
9. Vnukova N. The Influence of Competence Potential of Changes in Higher Education on the Training of Specialists for Entrepreneurship / N. Vnukova, S. Achkasova, M. Us, V. Pyvovarov // MARKETING OF SCIENTIFIC AND RESEARCH ORGANIZATIONS. – 2020. – Vol. 38. – Issue 4. – p. 49–68 (Poland). – Режим доступу: http://www.repository.hneu.edu.ua/bitstream/123456789/24752/1/Vnukowa_ang.pdf
10. Малишко Є. О. Пріоритетні напрями розвитку загальнообов'язкового накопичувального пенсійного забезпечення / Є. О. Малишко // Науковий вісник УжНУ. Серія: Міжнародні економічні відносини та світове господарство. – 2020. – Вип. 31/2020. – С. 59–66. – Режим доступу: http://www.visnyk-econom.uzhnu.uz.ua/archive/31_2020ua/12.pdf
11. Дзеніс В.О. Маркетинговий інструментарій в управлінні взаємовідносинами підприємства / В.О. Дзеніс, М.І. Ус // Інфраструктура ринку. – 2020. – № 42. – С. 164–170. – Режим доступу: <http://www.repository.hneu.edu.ua/handle/123456789/23245>
12. Ус М.І. Переваги стратегії формування ризик-орієнтованої системи накопичувального пенсійного забезпечення / М.І. Ус, С.А. Ачкасова // Економіка та суспільство. – 2021. – № 31. – Режим доступу: <https://economyandsociety.in.ua/index.php/journal/article/view/682> DOI: 10.32782/2524-0072/2021-31-18
13. Ус М. Дослідження впливу тайм-маркетингу на інструментарій маркетингових комунікацій на міжнародному ринку / М. Ус // Економіка та суспільство. – 2021. – № 26. – Режим доступу: <https://doi.org/10.32782/2524-0072/2021-26-46>
14. Pukala R. The application of weighted decision matrix for the selection of non-state pension provision strategy / R. Pukala, N. Vnukova, S. Achkasova, O. Gorokhovatskyi // Modern Machine Learning Technologies and Data Science Workshop 2020: Proceedings of the 2nd International Workshop on Modern Machine Learning Technologies and Data Science (MoMLeT+DS 2020). Volume I, (Lviv-Shatsk, Ukraine, June 2-3), 2020, CEUR-WS.org, Pp. 268–279. Режим доступу: <https://www.researchgate.net/publication/34>
15. Vnukova N. Decomposition of Google Trends Series for the Search of Patterns and Seasonality of Financial Risk Control Interest / N. Vnukova, S. Achkasova, O. Gorokhovatskyi, H. Pysarevska // Computational Linguistics and Intelligent Systems. Proceedings of the 5th International Conference on COLINS 2021. Volume I: Workshop (Kharkiv, 22–23 April 2021). – Vol. 1, 2021, CEUR-WS.org. – Pp. 613–628. Режим доступу: <http://www.repository.hneu.edu.ua/handle/123456789/254>
16. Iastremska O. Theoretical and methodological provision of justification of the enterprise activity efficiency in the marketing aspect / O. Iastremska, O. Gerasymov // Technology audit and production reserves. – 2020. – Vol. 2. – № 5(53). – P. 4 – 13. – Режим доступу: <http://journals.uran.ua/tarp/article/view/206402> фахове видання

(категорія Б)

17. Гавкалова Н. Л. Актуалізація необхідності інтенсифікації управління економічною поведінкою підприємств на основі аналізу економічних показників їх діяльності / Н. Л. Гавкалова, О. В. Гагарінов // Проблеми економіки. – 2020. – №2. – С. 224–239. <https://doi.org/10.32983/2222-0712-2020-2-224-239> фахове видання (категорія Б)

18. Ачкасова С. А. Кваліметрична модель оцінювання внутрішньої системи управління комплаєнс-ризиками в системі накопичувального пенсійного забезпечення / С. А. Ачкасова // Бізнес Інформ. – 2020. – № 12. – С. 338–347. – Режим доступу: https://www.business-inform.net/export_pdf/business-inform-2020-12_0-pages-338_347.pdf фахове видання (категорія Б)

19. Птащенко О. В. Ризик-орієнтована система фінансового забезпечення в умовах глобалізаційних змін / О. В. Птащенко // Бізнес Інформ. – 2020. – № 12. – С. 411–416. – Режим доступу: https://www.business-inform.net/export_pdf/business-inform-2020-12_0-pages-411_416.pdf фахове видання (категорія Б)

20. Малишко Є. О. Шляхи удосконалення механізму державного регулювання загальнообов'язкового накопичувального пенсійного забезпечення / Є. О. Малишко // Бізнес Інформ. – 2020. – № 12. – С. 347–354. – Режим доступу: https://www.business-inform.net/export_pdf/business-inform-2020-12_0-pages-347_354.pdf фахове видання (категорія Б)

21. Шорох В.Д. Визначення критеріїв розподілу учасників ринку небанківських фінансових послуг за умов оцінки їх ризиків / В.Д. Шорох // Ефективна економіка. – 2021. – № 4. DOI: 10.32702/2307-2105-2021.4.203 (фахове електронне видання)

22. Шорох В.Д. Удосконалення системи кількісних показників оцінки ризику діяльності фінансових компаній / В.Д. Шорох // Управління розвитком. – 2021. – №1. – С. 56-69

Х. Заключні відомості

Керівник юридичної особи

Пономаренко Володимир Степанович

д. е. н., 08.00.04

Перелік осіб-виконавців

Ачкасова Світлана Анатоліївна

(к. е. н.)

Безродна Олена Сергіївна

(к. е. н.)

Буряк Ірина Володимирівна

(к. е. н.)

Гагарінов Олексій Валерійович

Герасимов Олександр Костянтинович

(к.е.н.)

Давиденко Дар'я Олександрівна

(к. е. н.)

Койнаш Марина Іванівна

Малишко Євгенія Олегівна

(к. е. н.)

Огородня Євгенія Миколаївна

(к.е.н.)

Писаревська Ганна Іллівна

(к. е. н.)

Плескун Інна Володимирівна

(к.е.н.)

Птащенко Олена Валеріївна

(д. е. н., 08.00.02)

Пушкін Віктор Володимирович

Сотнікова Юлія Володимирівна

(к. е. н.)

Ус Марина Ігорівна

(к.е.н.)

Шорох Валерія Дмитрівна

Ягольницький Олександр Андрійович

(к. е. н.)

Відповідальний за підготовку

Шелкунова Наталія Леонідівна

облікових документів

Телефон

+38 (057) 702-06-70

Реєстратор

**Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є
відповідальним за реєстрацію наукової
діяльності**

